

不確実性の下での意思決定と数理モデル

研究集会

京都大学数理解析研究所の共同研究事業の1つとして、下記のように研究集会を催しますので、ご案内申し上げます。

研究代表者 高濱 節子
(広島修道大学・商学部)

記

日時：2005年11月7日(月) 10:00～
11月9日(水) 15:15

場所：京都大学数理解析研究所4階420号室
京都市左京区北白川追分町
市バス 京大農学部前 または 北白川 下車

プログラム

11月7日(月)

10:00～10:30 ○阪井 節子(広島修大・経営)
高濱 徹行(広島市立大・情報科学)
確率的比較を用いた制約付き最適化法「確率的変換法」の提案

10:30～11:00 ○丸山 健吾(阪大・情報科学)
齋藤 誠慈(阪大・情報科学)
小倉 裕介(阪大・情報科学)
谷田 純(阪大・情報科学)
石井 博昭(阪大・情報科学)
最大クリーク問題に関するDNAコンピューティングと行列解析による最適化

11:00～11:30 菊田 健作(兵庫県立大・経営)
A Rendezvous Search on a Linear Graph

11:30～12:00 ○松村 圭悟(阪大・経済)
大西 匡光(阪大・経済)
非期待効用の枠組みを用いたリスク回避の一考察

12:00～13:15 昼食

13:15～13:45 ○木村 俊一(北大・経済)
菊地 一哲(北大・経済)
American-Style Fractional Lookback Options

13:45～14:15 木村 俊一(北大・経済)
○菊地 一哲(北大・経済)
Valuing Continuous-Installment Options by Numerical Transform Inversion

14:15 ~ 14:45 ○矢萩 一樹 (電気通信大・電気通信)
宮崎 浩一 (電気通信大・電気通信)
格付けに応じてクーポンが変化する社債の評価法

14:45 ~ 15:15 ○山下晃一郎 (電気通信大・電気通信)
宮崎 浩一 (電気通信大・電気通信)
金利期間構造モデルとカルマンフィルター
(Frank de Jong and Pedro Santa-Clara 論文への批判)

15:15 ~ 15:30 休憩

15:30 ~ 16:00 ○ウイーラユット・ノムシリ (防大・理工)
山田 武夫 (防大・情報工)
片岡 靖詞 (防大・情報工)
多目的割当て問題のミニマックス最適化

16:00 ~ 16:30 林 杉 (阪大・経済)
○大西 匡光 (阪大・経済)
Optimal Portfolio Selection by CVaR-Based Sharpe Ratio
- Sequential Linear Programming Approach -

16:30 ~ 17:00 ○谷口 史晃 (防大・理工)
片岡 靖詞 (防大・情報工)
山田 武夫 (防大・情報工)
多目的ナップサック問題のマックスミン最適化

11月8日(火)

9:30 ~ 10:00 金 正道 (弘前大・理工)
最適距離選択について

10:00 ~ 10:30 ○北條 仁志 (大阪府立大・理)
寺岡 義伸 (大阪府立大・理)
離散型需要をもつ競合的在庫モデルについて

10:30 ~ 11:00 ○堀川 清之 (阪大・経済)
大西 匡光 (阪大・経済)
企業財務政策とインセンティブ

11:00 ~ 11:30 伊喜哲一郎(宮崎大・教育文科)
○堀口正之(東京電機大・情報環境)
安田正實(千葉大・理)
蔵野正美(千葉大・教育)
A learning algorithm for communicating Markov decision processes with unknown transition matrices

- 11:30 ~ 12:00 岩本 誠一 (九州大・経済)
○安田 正實 (千葉大・理)
Dynamic Programming creates The Golden Ration,too
- 12:00 ~ 13:15 昼食
- 13:15 ~ 13:45 玉置 光司 (愛知大・経営)
A note on the best choice problem related to the weighted random permutation
- 13:45 ~ 14:15 大鑄 史男 (名工大・機械)
セルオートマトンとその応用
- 14:15 ~ 14:45 中井 達 (九大・経済)
決定問題—公的投資モデルについて
- 14:45 ~ 15:15 中井 暉久 (関大・工)
A Distinction between Stable Equilibria in a Noncooperative Game
- 15:15 ~ 15:30 休憩
- 15:30 ~ 16:00 ○寺岡 義伸 (大阪府立大・理)
北條 仁志 (大阪府立大・理)
売り出しのノイジーゲーム
- 16:00 ~ 16:30 宝崎 隆祐 (防大・理工)
施設に対する査察資源割当を考慮した査察ゲーム
- 16:30 ~ 17:00 坂口 実 (大阪大学名誉教授)
Players' information in two-players games of "Score Showdown"

11月9日 (水)

- 10:00 ~ 10:30 ○石坂 宜宏 (鳥取大・工)
佐藤 毅 (鳥取大・工)
河合 一 (鳥取大・工)
不完全情報に基づく逐次点検方策について
- 10:30 ~ 11:00 ○田村 慶信 (鳥取環境大・環境情報)
山田 茂 (鳥取大・工)
OSS に対する ANP と SRGM に基づく最適バージョンアップ時期の推定問題に
関する一考察
- 11:00 ~ 11:30 ○林坂 弘一郎 (広大・工)
土肥 正 (広大・工)
打切少数サンプルに基づいた年齢取替方策の推定
- 11:30 ~ 12:00 ○小柳 淳二 (鳥取大・工)
河合 一 (鳥取大・工)
2種の期日遅れコストをもつ待ちを伴う仕事の最適処理政策

12:00 ~ 13:15 昼食

13:15 ~ 13:45 ○原口 和也 (京大・情報)
柳浦 睦憲 (京大・情報)
高い支持度と信頼度を持つ決定ルール数の期待値について

13:45 ~ 14:15 ○加藤浩介 (広島大・工)
坂和正敏 (広島大・工)
片桐英樹 (広島大・工)
宇野剛史 (広島大・工)
小川篤 (㈱シャープ・AV商品開発センター)
多目的確率計画問題に対する二次確率優越に基づく対話型ファジィ満足化手法

14:15 ~ 14:45 桑野 裕昭 (金沢学院大・経営情報)
ファジィ線形計画問題と灰色線形計画問題について

14:45 ~ 15:15 乾口 雅弘 (大阪大・基礎工)
複数の決定表のラフ集合解析: グループ決定への応用に向けて

以上